Fecha de Publicación: 27 de abril de 2020

Fecha de Información: 23 de abril de 2020 [1]

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$3339.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	850.8	452.4	238.0	567.0	43.3	112.7	171.2
15-35	695.6	922.2	703.4	235.9	13.8	254.7	205.0
36-60	144.3	72.7	40.2	140.0	32.5	4.3	0.0
61-90	43.2	216.1	190.0	0.0	26.1	43.2	0.0
91-180	44.1	237.3	211.0	10.0	16.3	24.1	10.0
>180	23.2	23.5	10.0	10.0	13.5	13.2	0.0
Total	**1801.3**	**1924.2**	**1392.6**	**962.9**	**145.5**	**452.2**	**386.2**

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.9 %	2.9 %	2.3 %	2.5 %
15-35	3.2 %	3.1 %	3.0 %	3.1 %
36-60	-	3.2 %	2.4 %	3.1 %
61-90	-	3.1 %	2.7 %	2.8 %
91-180	2.8 %	2.8 %	2.7 %	2.8 %
>180	-	2.7 %	2.6 %	2.7 %
Total	3.0 %	3.0 %	2.5 %	2.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	115	5595	5615	28	87	4998	5276	21	96	4344	4329
Intragrupo y off-shore***	0	0	2468	1854	0	0	2594	1332	0	0	2408	1319
Otros	115	37	1321	1916	87	28	823	1806	95	21	639	1744
Total	**152**	**152**	**9385**	**9385**	**116**	**116**	**8414**	**8414**	**116**	**117**	**7391**	**7391**

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

[1] Datos provisionales.

[2] El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.